

Fecha de publicación: 4 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 2 de Septiembre de 2003 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$219.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	71.3	35.0	6.0	42.3	77.3
15 a 35	110.3	51.0	6.0	65.3	116.3
36 a 60	1.2	2.1	1.1	0.2	2.3
61 a 90	-	1.5	1.5	-	1.5
91 a 180	-	17.5	17.5	-	17.5
>180	5.0	0.0	0.0	5.0	5.0
Total	187.8	107.2	32.2	112.8	219.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.4 %	5.3 %
15 a 35	9.1 %	8.9 %
36 a 60	9.3 %	9.1 %
61 a 90	9.2 %	9.0 %
91 a 180	9.6 %	9.0 %
>180	10.2 %	9.4 %
Total	9.5 %	7.7 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	106	66	364	189	13	25	295	128	22	25	215	153
Real	16	57	39	213	24	13	47	214	19	16	34	96
Total	122	122	403	403	37	37	342	342	41	41	248	248

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

³ A partir del 3 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.